



TITLE:

BMOにおける L^∞ と H^∞ (マルチンゲールにおける最近の発展)

AUTHOR(S):

風巻, 紀彦

CITATION:

風巻, 紀彦. BMOにおける L^∞ と H^∞ (マルチンゲールにおける最近の発展). 数理解析研究所講究録 1985, 565: 93-113

ISSUE DATE:

1985-07

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/99099>

RIGHT:

BMO における L^∞ と H^∞

富山大・理 風巻 紀彦 (Norihiko Kazamaki)

1. 序. L^∞ は, 有界な martingales M の全体を表し, H^∞ を $\langle M \rangle_\infty$ が有界である martingales M の全体とする。いずれも BMO の subclass である。§4 に例証してあるように, 両者の間に包含関係はない。最近, これらのクラスがどのような性格を有しているか興味を持って論べている。殆どは, 『weight 付に関する (A_p) 条件が成立する様子が, L^∞ との距離又は H^∞ との距離により左右されるのではないが, さらにその結果として, L^∞ および H^∞ を (A_p) 条件により characterize できはしまいか』という漠然とした考えに取付かれたことにある。然し実解析の人達は, この問題に殆んど関心を示していない。それは, (A_p) 条件と BMO の関係が martingale における程さけいに対応していないためと思われる。本稿では, こうした点にも少し触れながら, 幾分古い話から始めることにする。

まず, $0 < w \in L^1_{loc}(\mathbb{R}^1)$ とする。これを weight に持つ Hardy-Littlewood 型の不等式が成立するか否かの問題は, Muckenhoupt

が、その必要十分条件をあらえて解決した ([8])。すなわち

$$(A_p) \quad \sup_I \frac{1}{|I|} \int_I w(x) dx \left\{ \frac{1}{|I|} \int_I w(x)^{-\frac{1}{p-1}} dx \right\}^{p-1} < \infty \quad (1 < p < \infty)$$

がそれである。ただし、 I は区間、 $|I|$ は I の長さとする。また、

簡単のため、 $(A_\infty) = \bigcup_{1 < p < \infty} (A_p)$ とおくことにする。

Hunt-Muckenhoupt-Wheeden ([4]) は、これが Hilbert 変換に対する荷重ノルム不等式が成立するための必要十分条件でもあることを証明している。以下、 w が (A_p) 条件を満たすことを、 $w \in A_p$ で表す。

例 1 $|x| \in A_p \quad (p > 2)$ 。然し、 $\frac{1}{|x|} \notin A_\infty$

ところで (A_p) 条件と BMO-関数が関連することは、10 年位前から知られている。すなわち

$$(a) \quad w \in A_\infty \implies \log w \in \text{BMO}$$

$$(b) \quad \log w \in \text{BMO} \implies \exists \alpha > 0 : w(x)^\alpha \in A_\infty$$

例 1 から分かるように、残念ながら (a) の逆は成立しない。

従って、" $w \in A_\infty$ " と " $\log w \in \text{BMO}$ " が equiv. になっている

ない訳で、実解析の人達が上記の問題に興味を示さないのも
 肯ける。ところが、martingale の枠組の中では幸いなことに
 $\log w$ に代るものが存在し、それが BMO に属することによって $w \in A_\infty$
 を characterize することが可能である。この事に関しては、
 §3 で述べる。

2. (A_p) 条件による \bar{L}^∞ の特徴づけ。 Garnett-Jones の論
 文 [3] の中で、次の equiv. が implicitly に示されている：

$$w, w^{-1} \in \bigcap_{p>1} A_p \iff \log w \in \bar{L}^\infty$$

此処でこの結果を martingale の設定で解釈してみよう。まず、
 確率系 $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P}; (\mathcal{F}_t))$ を用意し、そこで定義された positive
 stochastic proc. $X = (X_t, \mathcal{F}_t)$ について、その sample conti. を
 仮定しておく。このとき、Muckenhoupt の (A_p) 条件は、次の
 形に翻訳される。

定義 1 $1 < p < \infty$ に対し

$$\sup_t \| X_t E[X_\infty^{-\frac{1}{p-1}} | \mathcal{F}_t]^{p-1} \|_\infty < \infty$$

がなりたつとき, X は (A_p) 条件を満たすといい, これを $X \in A_p$ で表すことにする。さらに, $(A_\infty) = \bigcup_{p>1} (A_p)$ とする。

次に, M を unif. integ. conti. martingale とし

$$p(M) = \inf \{ p > 1 : (E[e^{M_\infty} | \mathcal{G}_t]) \in A_p \}$$

と置く。一般に, $p(M) \neq p(-M)$ である。以下, 簡単のため

$$p^*(M) = \max \{ p(M), p(-M) \}$$

と置く。是より勿論 $p^*(M) \geq 1$ である。

Proposition 1 $\bar{L}^\infty = \{ M : p^*(M) = 1 \}$

証明は, Garbatt-Jones の考え方に忠実に従えばよい。

Lemma 1 $1 < p < \infty$ とする。次の2条件は equiv. である。

$$(\alpha_p) \quad \exists C_p > 0 : E[\exp\left\{ \frac{1}{p-1} |M_\infty - M_t| \right\} | \mathcal{F}_t] \leq C_p$$

$$(\beta_p) \quad \exists C_p > 0 : E[\exp\left\{ \frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t] E[\exp\left\{ -\frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t] \leq C_p$$

証明 $(\alpha_p) \Rightarrow (\beta_p) :$

$$E[\exp\left\{ \frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t] E[\exp\left\{ -\frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t]$$

$$= E[\exp\left\{ \frac{1}{p-1} (M_\infty - M_t) \right\} | \mathcal{F}_t] E[\exp\left\{ -\frac{1}{p-1} (M_\infty - M_t) \right\} | \mathcal{F}_t]$$

$$\leq E[\exp\left\{ \frac{1}{p-1} |M_\infty - M_t| \right\} | \mathcal{F}_t]^2$$

$(\beta_p) \Rightarrow (\alpha_p) :$ Jensen's ineq. を用いると

$$E[\exp\left\{ \frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t] E[\exp\left\{ -\frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t]$$

$$\geq \exp\left\{ \frac{1}{p-1} M_t \right\} E[\exp\left\{ -\frac{1}{p-1} M_\infty \right\} | \mathcal{F}_t]$$

$$\geq E[\exp\left\{ -\frac{1}{p-1} (M_\infty - M_t) \right\} | \mathcal{F}_t]$$

同様にして

$$\mathbb{E}[\exp\{\frac{1}{p-1}M_\infty\}|\mathcal{F}_t] \mathbb{E}[\exp\{-\frac{1}{p-1}M_\infty\}|\mathcal{F}_t] \geq \mathbb{E}[\exp\{\frac{1}{p-1}(M_\infty - M_t)\}|\mathcal{F}_t]$$

を得る。依って、 (β_p) から (α_p) もある。 \square

次に

$$a(M) = \sup\{a : \exists C_a > 0, \mathbb{E}[\exp\{a|M_\infty - M_t|\}|\mathcal{F}_t] \leq C_a\}$$

とかく。

Lemma 2 $p^*(M) < \infty$ ならば, $p^*(M) \leq 2$, $M \in \text{BMO}$, $p^*(M) - 1 = \frac{1}{a(M)}$.

証明 $p^*(M) < \infty$ のとき, 定義より

$$\exists p > 1 : (\mathbb{E}[e^{M_\infty}|\mathcal{F}_t]), (\mathbb{E}[e^{-M_\infty}|\mathcal{F}_t]) \in A_p$$

い.e.,

$$\exists C_p > 0 : \mathbb{E}[e^{M_\infty}|\mathcal{F}_t] \mathbb{E}[e^{-\frac{1}{p-1}M_\infty}|\mathcal{F}_t]^{p-1} \leq C_p$$

$$\mathbb{E}[e^{-M_\infty}|\mathcal{F}_t] \mathbb{E}[e^{\frac{1}{p-1}M_\infty}|\mathcal{F}_t]^{p-1} \leq C_p$$

ここで, $1 \leq \mathbb{E}[e^{M_\infty} | \mathcal{F}_t] \in [\mathbb{E}[e^{-M_\infty} | \mathcal{F}_t]]$ に注意すれば (β_p) が成
 立する。従って, 補題 1 により (α_p) が成立する。このとき, (α_p) と
 不等式 $x \leq e^x$ を用いて

$$\frac{1}{p-1} \in [M_\infty - M_t | \mathcal{F}_t] \leq C_p^{\frac{1}{p-1}}.$$

従って, $M \in \text{BMO}$ 。

次に, $\frac{1}{Q(M)} \leq p^*(M) - 1$ を示す。そのためには

$$(1) \quad p > p^*(M) \implies \frac{1}{Q(M)} < p-1$$

を証明すれば済む。上の計算から, $p > p^*(M)$ ならば, (α_p) が
 成立するので, $Q(M)$ の定義より, $\frac{1}{p-1} \leq Q(M)$ i.e., $\frac{1}{Q(M)} \leq p-1$ を
 得る。この結果は, $p > p' > p^*(M)$ なる p' に対してもなりたつ
 から, 実際は, $\frac{1}{Q(M)} < p-1$ が得られることになる。この逆
 向きの証明は後回しにして, $p^*(M) \leq 2$ を示しておく。 $p^*(M)$
 が有限のとき

$$\exists p > 1 : (\mathbb{E}[e^{M_\infty} | \mathcal{F}_t]), (\mathbb{E}[e^{-M_\infty} | \mathcal{F}_t]) \in A_p$$

$$(\mathbb{E}[e^{M_\infty} | \mathcal{F}_t]) \in A_p \text{ より, } \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1 \text{ なる } q \text{ に対し}$$

$$\begin{aligned}
& \in [e^{-\frac{1}{p-1}M_\infty} | \mathcal{G}_t] \in [e^{\frac{1}{q-1} \frac{1}{p-1} M_\infty} | \mathcal{G}_t]^{q-1} \\
& = \in [e^{M_\infty} | \mathcal{G}_t]^{\frac{1}{p-1}} \in [e^{-\frac{1}{p-1}M_\infty} | \mathcal{G}_t] \leq C_p
\end{aligned}$$

i.e.,

$$(\in [e^{-\frac{1}{p-1}M_\infty} | \mathcal{G}_t]) \in A_q.$$

同様にして, $(\in [e^{-M_\infty} | \mathcal{G}_t]) \in A_p$ から $(\in [e^{\frac{1}{p-1}M_\infty} | \mathcal{G}_t]) \in A_q$ がある。従って, $q > p^*(\frac{M}{p-1})$ 。このとき, (1) より, $\frac{1}{a(\frac{M}{p-1})} < q-1$ 。ここで, $a(\frac{M}{p-1}) = (p-1)a(M)$ に注意すれば

$$\frac{1}{a(M)} < (p-1)(q-1) = 1 \quad \text{i.e., } a(M) > 1.$$

従って, (α_2) が成立。このとき, 補題 1 より (β_2) がある。換言すれば, $(\in [e^{M_\infty} | \mathcal{G}_t])$ および $(\in [e^{-M_\infty} | \mathcal{G}_t])$ が (A_2) 条件を満たす。ゆえに, $p^*(M) \leq 2$ 。

最後に, $p^*(M) < \infty$ として, $p^*(M) - 1 \leq \frac{1}{a(M)}$ を示そう。そのために,

$$\frac{1}{a(M)} < p-1 \implies p^*(M) \leq p$$

を検証すればよい。 $p^*(M) \leq 2$ であるから, $p \geq 2$ のときは明

ら。従って, $1 < p < 2$ の場合を処理すれば済む。 $Q(M) > \frac{1}{p-1}$ なる仮定から直ちに (α_p) と (β_p) がある。 $\frac{1}{p-1} > 1$ に注意すれば、

$$\begin{aligned} \epsilon[e^{M_\infty} | \mathcal{F}_t]^{\frac{1}{p-1}} &\in [e^{-\frac{1}{p-1} M_\infty} | \mathcal{F}_t] \\ &\leq \epsilon[e^{\frac{1}{p-1} M_\infty} | \mathcal{F}_t] \epsilon[e^{-\frac{1}{p-1} M_\infty} | \mathcal{F}_t] \leq C_p \end{aligned}$$

i.e.,

$$(\epsilon[e^{M_\infty} | \mathcal{F}_t]) \in A_p$$

同様にして, $(\epsilon[e^{-M_\infty} | \mathcal{F}_t]) \in A_p$ が求まる。従って $p^*(M) \leq p$ 。

□

次に $1 \leq p < \infty$ に対し

$$\|M\|_{BMO_p} = \sup_t \|\epsilon[|M_\infty - M_t|^p | \mathcal{F}_t]\|_\infty^{1/p}$$

とおく。このとき、不等式

$$\exists C_p > 0 : \|M\|_{BMO_1} \leq \|M\|_{BMO_p} \leq C_p \|M\|_{BMO_1}$$

の成立は良く知られている。

さらに $M, N \in \text{BMO}$ に対し, $d_p(M, N) = \|M - N\|_{\text{BMO}_p}$ とおく。

Lemma 3 (Varopoulos [10], Emery [2])

$$\frac{1}{4 d_1(M, L^\infty)} \leq \alpha(M) \leq \frac{4}{d_1(M, L^\infty)}$$

Prop. 1 の証明. $p^*(M) < \infty$ のとき, 補題 2 より $p^*(M) - 1 = 1/\alpha(M)$ 。さらに補題 3 を用いれば

$$(2) \quad \frac{1}{4} d_1(M, L^\infty) \leq p^*(M) - 1 \leq 4 d_1(M, L^\infty)。$$

従って, 特に $p^*(M) = 1$ ならば $M \in \overline{L^\infty}$ となる。

逆に $M \in \overline{L^\infty}$ ならば, 補題 3 から $\alpha(M) = \infty$ 。このとき, (α_2) が成立するから (β_2) も成立。つまり $p^*(M) \leq 2 < \infty$ 。

従って, (2) の右側不等式より $p^*(M) = 1$ が求まる。 \square

3. Exponential Martingale と BMO. $(\Omega, \mathcal{F}, P; (\mathcal{F}_t))$

を確率系とし, あたえられた weight 対 $0 < w \in L^1(\Omega)$ から

martingale $w_t = E[w | \mathcal{G}_t]$ を求める。測度の変換は、確率論においても重要な変換の一つであるが、 $w dP$ もまた確率測度であるという制約が加わるため、必然的に $E[w] = 1$ を仮定して論ずることになる。以下簡単のため $w_0 = 1$ とし、 (\mathcal{G}_t) が生み出す martingale の sample conti. を仮定して話を進めることにする。

確率積分の理論においては、weight martingale (w_t) が martingale $M_t = \int_0^t w_s^{-1} dw_s$ を用いて次のように表せることは良く知られた事柄である：

$$(3) \quad w_t = \exp\left(M_t - \frac{1}{2} \langle M \rangle_t\right)$$

ただし、 $\langle M \rangle$ は、 $M^2 - \langle M \rangle$ が martingale となる conti. increas. proc. である。このとき、§1 の (a), (b) と対称的に次の結果がなりたつ。

Proposition 2 ([5]) 次の3条件は equiv. である。

$$(i) \quad M \in BMO \quad (ii) \quad (w_t) \in A_\infty \quad (iii) \quad \sup_t \left\| E\left[\log^+ \frac{w_t}{w_\infty} \mid \mathcal{G}_t\right] \right\|_\infty < \infty$$

証明 (i) \Rightarrow (ii) : $\|M\|_{BMO_2} < \sqrt{2}(\sqrt{p}-1)$ なる p に対し,
 $(w_t) \in A_p$ を示す。まず, 実数 λ に対し

$$w_t^{(\lambda)} = \exp\left(\lambda M_t - \frac{\lambda^2}{2} \langle M \rangle_t\right)$$

もまた unit. integ. martingale をなすことに注意しておく。

つまり, $E[w_\infty^{(\lambda)} / w_t^{(\lambda)} | \mathcal{F}_t] = 1$ である。次に, $r = \sqrt{p} + 1$,

$\alpha = (\sqrt{p} + 1) / \sqrt{p}$ とおくと, $\frac{1}{\alpha(\sqrt{p}-1)^2} - \frac{r}{(p-1)^2} = \frac{1}{p-1}$ がなりたつ

から, Hölder's ineq. と John-Nirenberg's ineq. を用いれば

$$\begin{aligned} E\left[\left(\frac{w_t}{w_\infty}\right)^{\frac{1}{p-1}} \middle| \mathcal{F}_t\right] &= E\left[\exp\left\{-\frac{1}{p-1}(M_\infty - M_t) - \frac{r}{2(p-1)^2}(\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t)\right\}\right. \\ &\quad \times \exp\left\{\frac{1}{2\alpha(\sqrt{p}-1)^2}(\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t)\right\} \middle| \mathcal{F}_t\right] \\ &\leq E\left[\frac{w_\infty^{(\lambda)}}{w_t^{(\lambda)}} \middle| \mathcal{F}_t\right]^{\frac{1}{r}} E\left[\exp\left\{\frac{1}{2(\sqrt{p}-1)^2}(\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t)\right\} \middle| \mathcal{F}_t\right]^{\frac{1}{\alpha}} \\ &\leq \left\{1 - \frac{1}{2(\sqrt{p}-1)^2} \|M\|_{BMO_2}^2\right\}^{\frac{1}{\alpha}} \quad \left(\lambda \equiv -\frac{r}{p-1}\right) \end{aligned}$$

従って, $(w_t) \in A_p$.

(ii) \Rightarrow (iii) : $(w_t) \in A_p$ ($p > 1$) のとき,

$$\exists C_p > 0 : \exp \left\{ \frac{1}{p-1} \mathbb{E} \left[\log^+ \frac{w_t}{w_\infty} \mid \mathcal{F}_t \right] \right\} \leq \mathbb{E} \left[\left(\frac{w_t}{w_\infty} \right)^{\frac{1}{p-1}} \mid \mathcal{F}_t \right] + 1 \leq C_p$$

従って, $\mathbb{E} \left[\log^+ \frac{w_t}{w_\infty} \mid \mathcal{F}_t \right] \leq (p-1) \log C_p$.

(iii) \implies (i): M が unif. integ. martingale の場合を処理すればよい。このとき

$$\begin{aligned} \mathbb{E} \left[\log^+ \frac{w_t}{w_\infty} \mid \mathcal{F}_t \right] &\geq \mathbb{E} \left[M_t - M_\infty + \frac{1}{2} (\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t) \mid \mathcal{F}_t \right] \\ &\geq \frac{1}{2} \mathbb{E} [\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t \mid \mathcal{F}_t] \end{aligned}$$

従って, (iii) から $\|M\|_{BMO_2} < \infty$ がある。 \square

因に, $M_\infty - \log w = \frac{1}{2} \langle M \rangle_\infty$ である。ここまでの話は, 先ず weight martingale (w_t) をあたえ, martingale M_t を定義して論じてきたが, 逆に $M \in BMO$ を任意にあたえて式(3)により (w_t) を定義する場合にも全く同じ equiv. を得ることがある。そこで, いま $M \in BMO$ を任意にあたえたとき, これに対応する (w_t) がどの (A_p) 条件を満たすかを討るために

$$a(M) = \inf \{ p > 1 : (w_t) \in A_p \}$$

とおく。 Hölder's ineq. から簡単に, $p > a(M) \implies (w_t) \in A_p$ がある。この逆もまた成立することが分る。

次に, $a^*(M) = \max\{a(M), a(-M)\}$ とおく。このとき, [6] で指摘してあるように,

$$p > a^*(M) \implies d_1(M, L^\infty) < 8(\sqrt{p}-1)$$

がなりたつ。従って, $\{M : a^*(M) = 1\} \subset \overline{L^\infty}$ である。ところが, 案に相違してこの逆が成立しない。そのことを次に例証しておく。

例 2 (B_t) を 1 次元の Brownian Motion ($B_0 = 0$) とし, $M = B^\tau$ とおく。ただし, $\tau = \inf\{t : |B_t| = 1\}$ 。定義より $|M| \leq 1$ だから当然, $d_1(M, L^\infty) = 0$ 。他方

$$\mathbb{E}\left[\left(\frac{w_t}{w_\infty}\right)^{\frac{1}{p-1}} \mid \mathcal{F}_t\right] \geq e^{-\frac{2}{p-1}} \mathbb{E}\left[\exp\left\{\frac{1}{2(p-1)}(\tau - t \wedge \tau)\right\} \mid \mathcal{F}_t\right]$$

しかも, $\alpha > \pi^2/8$ に対し $\mathbb{E}[e^{\alpha\tau}] = \infty$ ([9] の Prop. 8.4) だから $1 < p < 1 + 4/\pi^2$ とすると $1/\{2(p-1)\} > \pi^2/8$ となり $(w_t) \notin A_p$ 。従って, $a^*(M) \geq 1 + 4/\pi^2$ となる。

4. H^∞ と (A_p) 条件. §1 で述べたように H^∞ と L^∞ の間には包含関係がない。そのような例は簡単につくれる。実際に $(B_{t \wedge 1}) \in H^\infty \setminus L^\infty$ であり, 例 2 の $M = B^2$ は有界ではあるが $d_2(M, H^\infty) \gg 2/\pi$ となってしまう。然しながら, 一般に $H^\infty \subset \overline{L^\infty}$ がなりたつことが分る ([7])。しかも Dellacherie-Meyer-Yor ([1]) により trivial case を除き, $\overline{L^\infty} \neq BMO$ であることが示されているので, H^∞ もまた BMO で稠密ではないことになる。

Proposition 3 ([7]) $d_2(M, H^\infty) < \sqrt{p} - 1 \implies \alpha^*(M) < p$

証明 先ず,

$$\beta(M) = \sup \left\{ b > 0 : \exists C_b > 0, \in [\exp\{b^2(\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t)\} | \mathcal{F}_t] \leq C_b \right\}$$

とおき

$$(4) \quad \frac{1}{\sqrt{2} d_2(M, H^\infty)} \leq \beta(M)$$

を示す。 $0 < b < \frac{1}{\sqrt{2} d_2(M, H^\infty)}$ のとき

$$\exists N \in H^\infty : b < \frac{1}{\sqrt{2} d_2(M, N)} .$$

他方 $\lambda < t$ に対し, $\langle M \rangle_t - \langle M \rangle_\lambda \leq 2\{(\langle M-N \rangle_t - \langle M-N \rangle_\lambda) + (\langle N \rangle_t - \langle N \rangle_\lambda)\}$

および $\langle N \rangle \leq C$ に注意すれば

$$\begin{aligned} E[\exp\{b^2(\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t)\} | \mathcal{G}_t] &\leq E[\exp\{2b^2(\langle M-N \rangle_\infty - \langle M-N \rangle_t) + (\langle N \rangle_\infty - \langle N \rangle_t)\} | \mathcal{G}_t] \\ &\leq e^{2b^2C} E[\exp\{2b^2(\langle M-N \rangle_\infty - \langle M-N \rangle_t)\} | \mathcal{G}_t] \end{aligned}$$

John-Nirenberg's ineq. より, 右辺は $e^{2b^2C} \{1 - 2b^2 \|M-N\|_{BMO_2}^2\}^{-1}$

より小である。従って, $b \leq \beta(M)$ となり (4) を得る。

次に $d_2(M, H^\infty) < \sqrt{p}-1$ としよう。(4) から $\beta(M) > \frac{1}{\sqrt{2}(\sqrt{p}-1)}$ 。

さらに Prop. 2 (i) \Rightarrow (ii) の証明のように, $r = \sqrt{p}+1$, $\lambda = \frac{\sqrt{p}+1}{\sqrt{p}}$

において Hölder's ineq. を用いると

$$E\left[\left(\frac{w_t}{w_\infty}\right)^{\frac{1}{p-1}} \middle| \mathcal{G}_t\right] \leq E\left[\frac{w_\infty^{(\lambda)}}{w_t^{(\lambda)}} \middle| \mathcal{G}_t\right]^{\frac{1}{r}} E\left[\exp\left\{\frac{1}{2(\sqrt{p}-1)^2}(\langle M \rangle_\infty - \langle M \rangle_t)\right\} \middle| \mathcal{G}_t\right]^{\frac{1}{\lambda}}$$

従って, $\alpha(M) < p$. 同様にして $\alpha(-M) < p$ がある。ゆえに $\alpha^*(M) < p$. \square

Corollary. $\overline{H^\infty} \subset \{M : \alpha^*(M) = 1\}$.

$\overline{H}^\infty = \{M : \alpha^*(M) = 1\}$ がなりたつか否かは、興味深い問題
 と思えるが、今のところ不明である。手掛りは、(4)の逆向き
 不等式

$$\exists C > 0 : \beta(M) \leq \frac{C}{d_2(M, H^\infty)}$$

を得ることであるが、これも果してなりたつものやら皆目分
 らない。その他、 H^∞ は BMO において充分 closed ではないだ
 ろうと考えているが、これも不明のままである。

ところで、 $\alpha(M) = \alpha(-M)$ が一般になりたつだろうか？
 これは 7, 8 年前からえになっていった問題で、最近になり漸く
 negative example が得られた。明らかになって見れば当然前
 みれたいなものだが、擬摺らされた分変着のようなものもあるの
 で、それを次に紹介しておく。

例 3. (B_t) を確率系 $(\Omega, \mathcal{F}, Q; (\mathcal{F}_t))$ 上の 1 次元 Brownian
 Motion で $Q(B_0 = 0) = 1$ とし

$$\tau = \inf \{t : |B_t| = 1\}$$

と置く。このとき $\{\exp(B_{t \wedge \tau} - \frac{1}{2}(t \wedge \tau)), \mathcal{F}_t\}$ は, unif. integ.

martingale/ \mathbb{Q} である。従って, $dP \equiv \exp(B_\tau - \frac{1}{2}\tau) dQ$ は確率測度となる。次に, $M_t \equiv t \wedge \tau - B_{t \wedge \tau}$ とおくと, Girsanov の定理から, これは conti. martingale/ \mathbb{P} で $\langle M \rangle_t = t \wedge \tau$ 。 M に対する weight martingale は,

$$w_t = \exp\left\{(t \wedge \tau - B_{t \wedge \tau}) - \frac{1}{2}(t \wedge \tau)\right\} = \exp\left\{\frac{1}{2}(t \wedge \tau) - B_{t \wedge \tau}\right\}$$

従って, 任意の $1 < p < \infty$ に対し

$$\mathbb{E}\left[\left(\frac{w_t}{w_\infty}\right)^{\frac{1}{p-1}} \mid \mathcal{F}_t\right] = \mathbb{E}\left[\exp\left\{-\frac{1}{2(p-1)}(\tau - t \wedge \tau) + \frac{1}{p-1}(B_\tau - B_{t \wedge \tau})\right\} \mid \mathcal{F}_t\right]$$

$$\leq \exp\left\{\frac{2}{p-1}\right\} \quad \therefore Q(M) = 1.$$

従って $1 < p < \frac{16 + \pi^2}{4 + \pi^2}$ のとき, $p < 2$, $\frac{4-p}{2(p-1)} > \frac{\pi^2}{8}$ で, しかも

$$\mathbb{E}\left[\left\{\frac{w_t^{(-1)}}{w_\infty^{(-1)}}\right\}^{\frac{1}{p-1}} \mid \mathcal{F}_t\right] = \mathbb{E}_Q\left[\frac{w_\infty}{w_t} \left\{\frac{w_t^{(-1)}}{w_\infty^{(-1)}}\right\}^{\frac{1}{p-1}} \mid \mathcal{F}_t\right]$$

$$= \mathbb{E}_Q\left[\exp\left\{\frac{p-2}{p-1}(B_\tau - B_{t \wedge \tau}) + \frac{4-p}{2(p-1)}(\tau - t \wedge \tau)\right\} \mid \mathcal{F}_t\right]$$

$$\geq \exp\left\{-\frac{2(2-p)}{p-1}\right\} \mathbb{E}_Q\left[\exp\left\{\frac{4-p}{2(p-1)}(\tau - t \wedge \tau)\right\} \mid \mathcal{F}_t\right]$$

従って, 例 2 で述べたように $E_Q[e^{\alpha z}] = \infty$ ($\alpha > \frac{\pi^2}{8}$) である点
を考慮すれば, $w^{(-1)} \notin A_p$ 。つまり, $a(-M) \geq \frac{16+\pi^2}{4+\pi^2} > 1$ とな
り $a(M) \neq a(-M)$ である。

注意 $D = \{z \in \mathbb{C} : |z| < 1\}$ とし, $w(e^{i\theta})$ を ∂D 上の weight $\#$
とする。次に (Z_t) を complex Brownian motion, $Z_0 = 0$ とし

$$\tau = \inf\{t : |Z_t| = 1\}, \quad \mathcal{F}_t = \mathcal{G}(Z \wedge \tau, s \leq t)$$

とおく。 w から weight martingale $w_t = E[w(Z_\tau) | \mathcal{F}_t]$ を定
義する。 (w_t) は w の Poisson 積分 $u(z)$ ($z \in D$) により, w_t
 $= u(Z_t \wedge \tau)$ とかけるので, $M_t = \int_0^{t \wedge \tau} \frac{1}{u(Z_s)} d u(Z_s)$ 。 Prop. 3 に
より, $d_2(M, H^\infty) < \sqrt{p}-1$ から $(w_t) \in A_p$ がある。他方, 未発
表ではあるが, martingale における (A_p) から classical (A_p) が
あるという 廣口—塩田 の結果があるので, 結局 $d_2(M, H^\infty) <$
 $\sqrt{p}-1$ のとき, $w \in A_p$ が得られたことになる。

参 考 文 献

- [1] C. Dellacherie, P. A. Meyer and M. Yor, Sur certaines

- propriétés des espaces de Banach H^1 et BMO, Sémin. Prob. XII, Lecture Notes in Math. 649 (1978), 98-113.
- [2] M. Emery, Le théorème de Garnett-Jones d'après Varopoulos, Sémin. Prob. XV, Lecture Notes in Math. 850 (1981), 278-284.
- [3] J. B. Garnett and P. W. Jones, The distance in BMO to L^∞ , Ann. Math. 108 (1978), 373-393.
- [4] R. Hunt, B. Muckenhoupt and R. Wheeden, Weighted norm inequalities for the conjugate function and Hilbert transform, Trans. Amer. Math. Soc., 176 (1973), 227-251.
- [5] N. Kazamaki, A characterization of BMO-martingales, Sémin. Prob. X, Lecture Notes in Math. 511 (1976), 536-538.
- [6] ———, Martingale における Garnett-Jones の定理と (A_p) 系件, 数理解析研究所講究録 491 (1983), 158-170.
- [7] N. Kazamaki and Y. Shiota, Remarks on the class of continuous martingales with bounded quadratic variation, Tôhoku Math. Journ., 37 (1985), 801-806.
- [8] B. Muckenhoupt, Weighted norm inequalities for the Hardy maximal function, Trans. Amer. Math. Soc., 165 (1972), 207-226.
- [9] S. C. Port and C. J. Stone, Brownian Motion and Classical Potential Theory, Academic Press 1978.

- [10] N. Th. Varopoulos, A probabilistic proof of the Garnett-Jones theorem on BMO, *Pacific J. Math.*, 90 (1980) 201-221.